

平成15年度 年金資金運用基金の資金運用の結果について

15年度の年金資金運用基金の運用結果

15年度の年金資金運用基金の運用結果は、プラス4兆8,724億円でした。

また、損益合計は、旧年金福祉事業団から承継した15年度分借入利息4,417億円を差し引いた、プラス4兆4,306億円となりました。

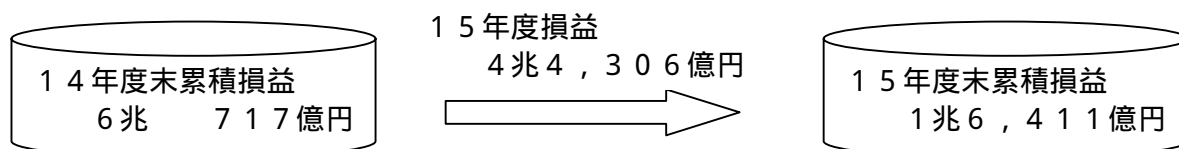
【15年度の損益】

市場運用分			
・ 総合収益額	4兆7,225億円	}	4兆8,724億円
・ 修正総合収益率	12.48%		
運用手数料等	193億円		
財投債の収益額	1,691億円		
借入利息	4,417億円	→	15年度損益合計 4兆4,306億円

(参考)

年金資金運用基金発足以来の市場運用の累積運用収入は、プラス1兆4,784億円です。

また、旧年金福祉事業団時代を含めた平成15年度末の累積利差損は、1兆6,411億円となっています。



年金積立金全体で見た運用状況

年金積立金全体(年金資金運用基金の運用分と財政融資資金への預託分との合計)の運用結果は、約6兆8,700億円の黒字となる見込みです。

【15年度の損益】

年金資金運用基金分	4兆4,306億円
財政融資資金への預託金の利子収入	+ 約2兆4,400億円(見込み)
年金積立金全体の損益合計	約6兆8,700億円のプラス

年金積立金全体の運用結果については、厚生労働大臣が作成する年金積立金運用報告書において公表(今秋を予定)する予定です。

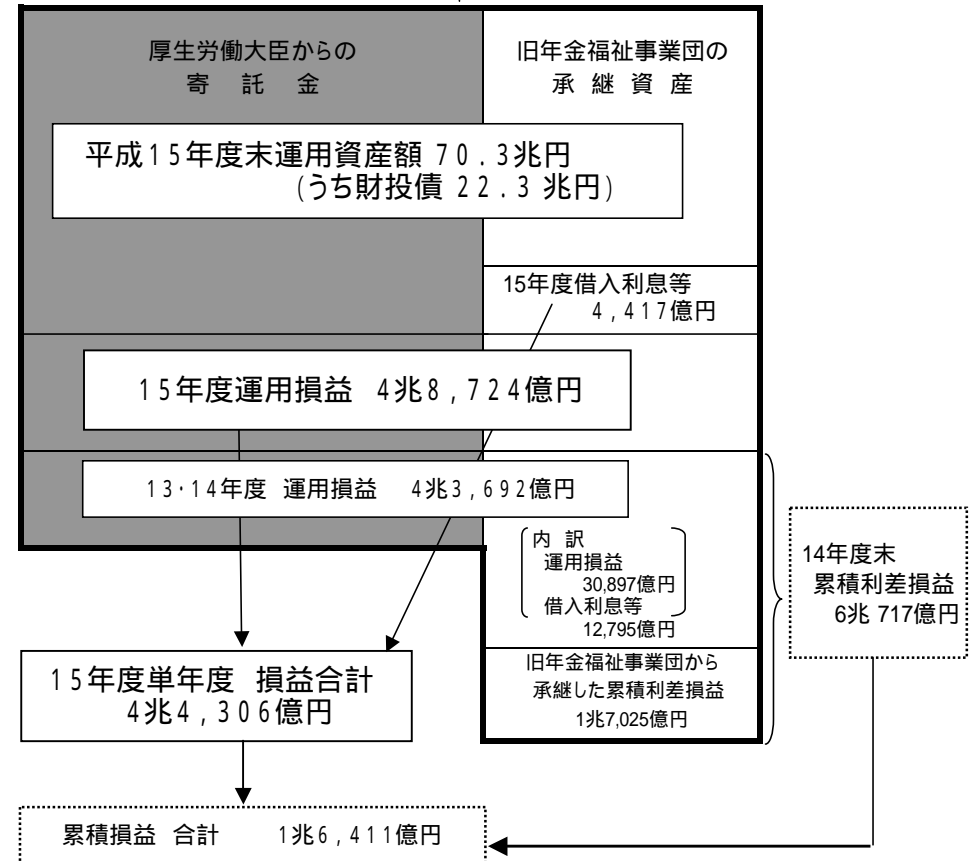
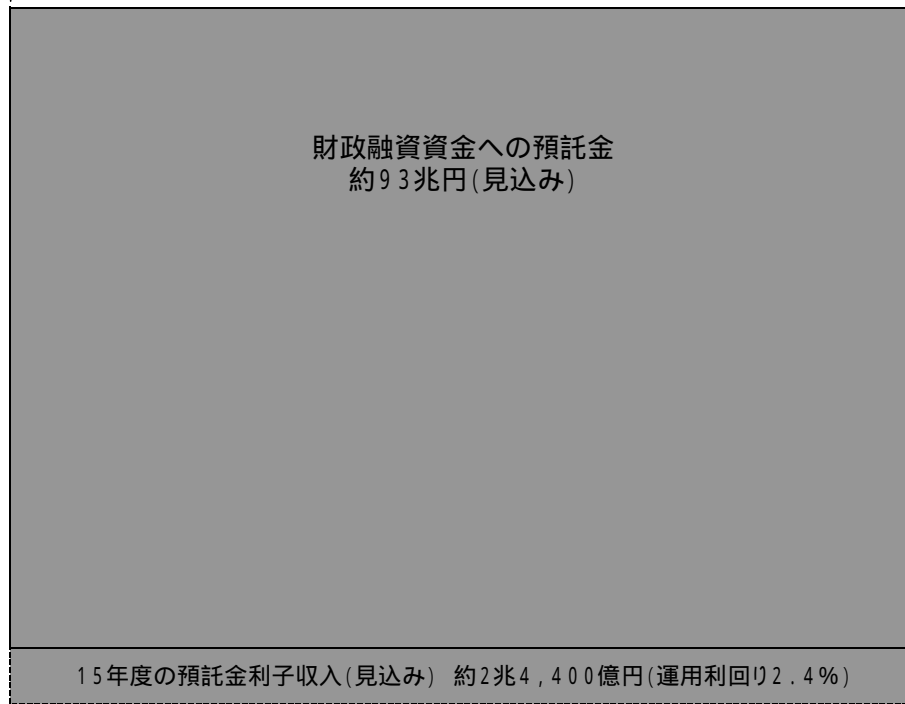
(参考1) 平成15年度 年金積立金及び年金資金運用基金の運用資産の運用結果

年金積立金

年金資金運用基金の運用資産

「厚生年金保険及び国民年金における年金積立金運用報告書」において運用結果を公表(本年秋に公表見込み)【厚生労働大臣】

今回の「資金運用業務概況書」において運用結果を公表【年金資金運用基金】



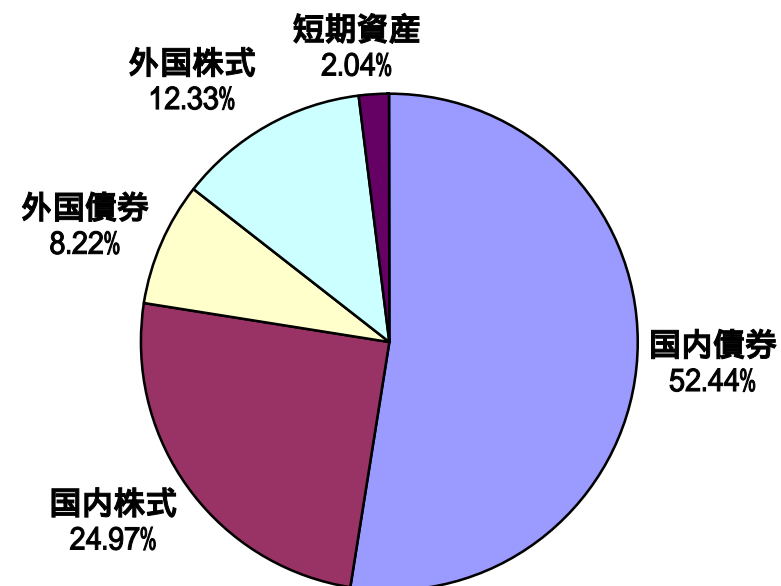
注1) 網掛け部分は「年金積立金」、太枠線部分は年金資金運用基金の運用資産。
注2) 「15年度末運用資産額」の中には未払費用等を含んでいる。

(参考2) 年金資金運用基金の運用資産の構成状況(平成16年3月末現在)

	時価総額(億円)	構成比	移行ポート フォリオ	乖離状況
国内債券	252,012	52.44%	55.00%	-2.56%
国内株式	120,019	24.97%	21.00%	3.97%
外国債券	39,520	8.22%	9.00%	-0.78%
外国株式	59,255	12.33%	13.00%	-0.67%
短期資産	9,804	2.04%	2.00%	0.04%
合計	480,610	100.00%	100.00%	-

財投債(簿価)	222,801 (時価総額 222,897)
---------	---------------------------

時価総額(市場運用分)

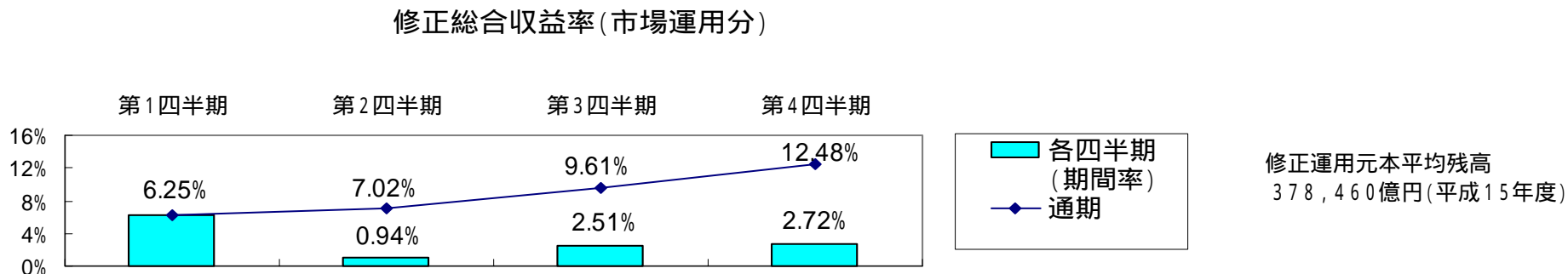


注1) 上記の数値は四捨五入のため、各数値の合算は合計の値と必ずしも合致しません。

注2) 時価総額は未収収益及び未払費用等を含みます。

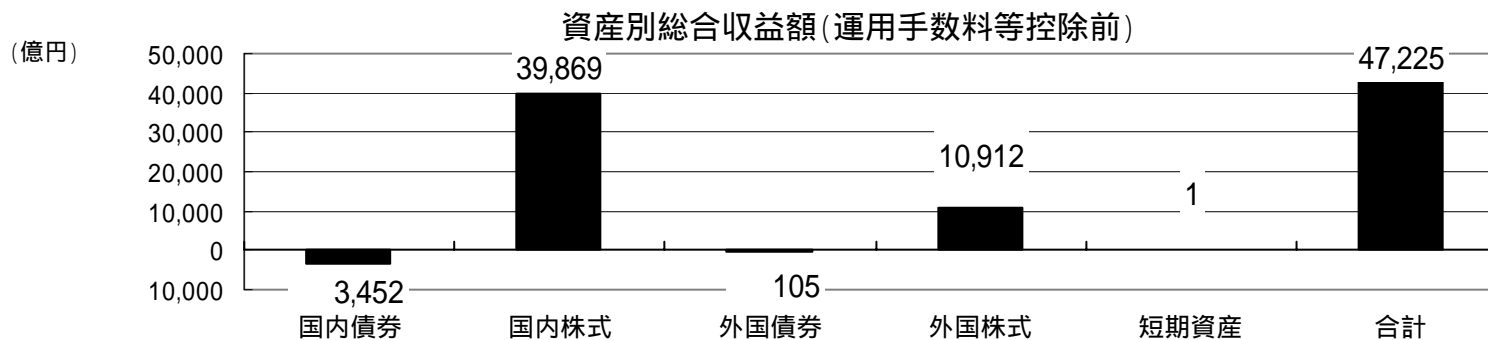
注3) 財投債(簿価)欄は未収収益を含んだ償却原価法による簿価です。

(参考3) 平成15年度 四半期ごとの資産全体の修正総合収益率(期間率)

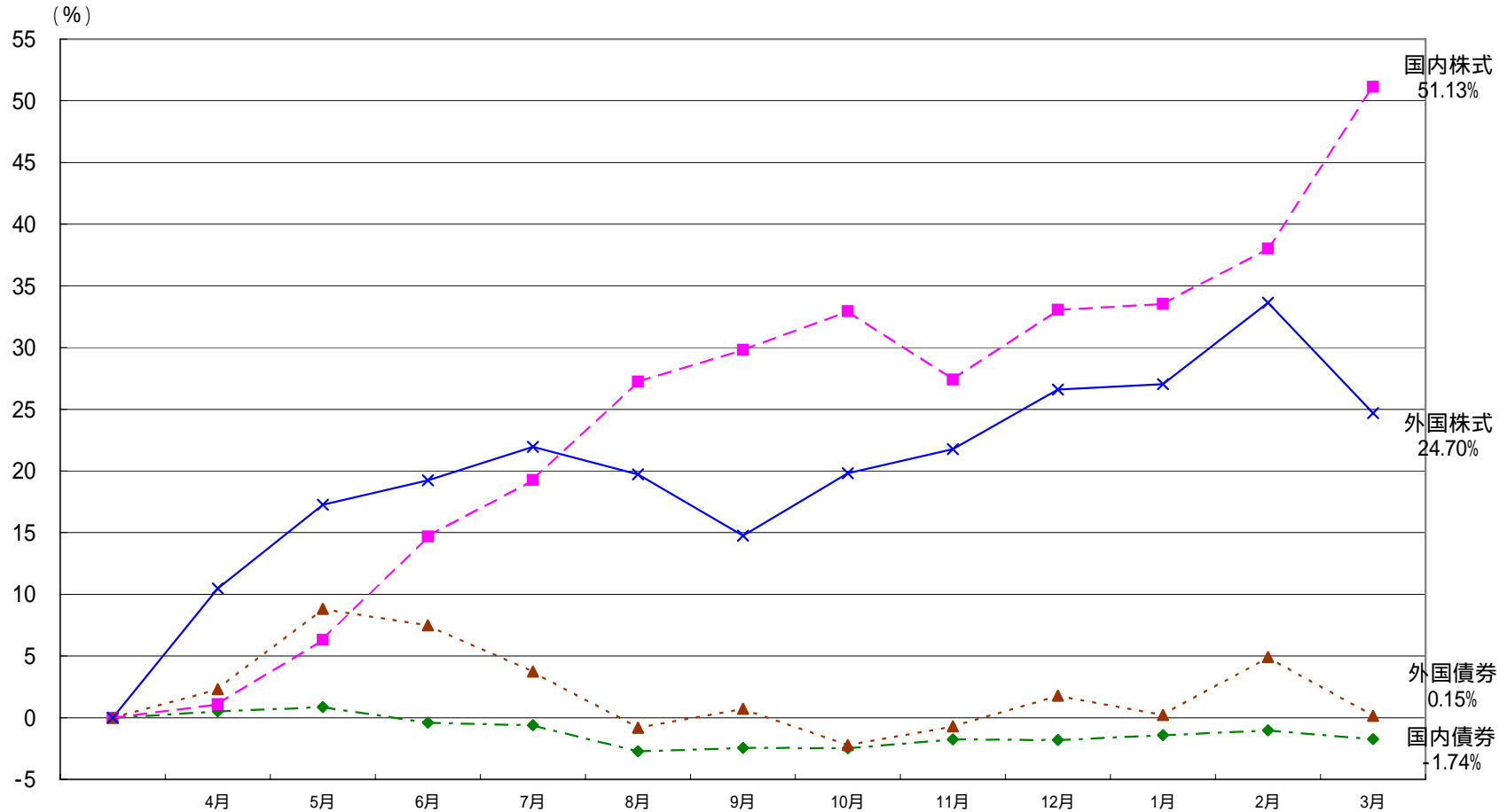


(注)修正総合収益率 = 総合収益額 ÷ 修正運用元本平均残高 (運用元本平均残高 + 前期末未収収益 + 前期末評価損益)

(参考4) 平成15年度 資産別総合収益額(市場運用分。運用手数料等控除前。)



(参考5) ベンチマーク収益率(累積)の推移



ベンチマーク騰落率

	平成15年4月～平成16年3月
国内債券 (NOMURA-BPI総合)	- 1.74%
国内株式 (TOPIX配当込)	51.13%
外国債券(円ベース) (シティグループ世界国債インデックス)	0.15%
外国株式(円ベース) (MSCI-KOKUSAI)	24.70%

運用環境

	平成15年3月末	平成16年3月末
国内債券 (新発10年国債利回り)	0.700%	1.440%
国内株式 (日経225)	7,972.71円	11,715.39円
(TOPIX)	788.00ポイント	1,179.23ポイント
外国債券 (米国10年国債利回り)	3.80%	3.83%
(シティグループ世界国債インデックス)	254.02ポイント	254.41ポイント
外国株式 (NY ダウ)	7,992.13ドル	10,357.70ドル
(MSCI-KOKUSAI)	780.704ポイント	973.517ポイント
為替 (円 / ドル)	118.580円	104.035円
(円 / ユーロ)	129.395円	127.849円

(注) 為替レートはWMロイター社ロンドン16時仲値(対米ドル)を採用しています。

(注)

(参考6)

【運用の仕組み（平成13年度から）】

(ポイント)

厚生労働大臣による自主運用。
資金運用部への預託義務の廃止。
厚生労働大臣は、基金に資金を寄託することにより運用。

図の数値は平成15年度末時点の残高。

旧年金福祉事業団の資金運用業務は基金が承継し、承継資金運用業務として、平成22年度まで実施。

